

Central Daily Market Report

2021年7月8日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2021年7月8日		2021年7月9日		2021年7月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 500		200		0	
財政	4,400		▲ 19,600		10,000	
資金過不足	3,900		▲ 19,400		10,000	
金融調節						
	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,400					
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入					1,300	
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給						
<small>*ドル資金供給用担保提供額</small>						
当預増減	13,300		▲ 19,400		11,300	
当座預金残高	5,330,500		5,311,100		5,322,400	
準備預金残高	4,697,300					
積み終了先	4,697,300		7月9日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,697,300		積数	100		
非準備預金先	633,200		1日平均	0		
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,627,900	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	76.67%		

●2021年7月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、調達姿勢の違いが見られるなか、昨日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは国内勢から▲0.05~▲0.015%の水準での調達が見られた。一巡後は▲0.06~▲0.015%のレンジの出合いが見られた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(7/9-7/12)は、▲0.075~▲0.065%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では2Y410~426、5Y140~147、10Y345~363、20Y170~176、30Y59~70、40Y10~14等にビッドの出入りがあった。

<短国市場>

本日はTB6M物(1006回)の入札が実施された。WI取引において▲0.103%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1116%、按分落札利回▲0.1096%と、やや強い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.123%での出合いが見られるなど、堅調に推移した。この他に1Y物が▲0.116~0.115%、3M物が▲0.103%で出合った。

<CP市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。発行市場は償還総額200億円程度に對して、発行総額は350億円程度と発行超であった。小型案件を中心とする落ち着いたマーケットとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/7/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.071	0.025	▲ 0.005	28,118.03	▲ 248.92	110.62-63	109.78-79
T/N	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.074						
S/N			▲ 0.015				-	-						
1W	▲ 0.028	▲ 0.015	▲ 0.024				-	▲ 0.078						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.086						
1M	▲ 0.018	0.120	0.029				-	▲ 0.090						
3M			0.010				▲ 0.103	▲ 0.100						
6M							▲ 0.123	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.129						
									日付	7/1	7/2	7/5	7/6	7/7
									日銀当預残	5,355,400	5,295,500	5,296,600	5,308,800	5,317,200
									準備預金残	4,725,900	4,661,200	4,695,900	4,686,500	4,704,900
									マネタリーベース	6,572,500	6,513,000	6,513,500	6,525,700	6,533,800
									無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.027%	▲0.031%	▲0.032%	▲0.032%
									コール市場残高	133,435	143,185	132,909	132,010	133,796
									うち無担	114,452	122,228	111,449	112,062	113,134
									うちO/N	67,906	70,317	58,208	57,516	57,638
									うち有担	18,983	20,957	21,460	19,948	20,662

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1006	-	34,000	2021/7/12	2022/1/11	130,193.0	27,699.7	100.0550	▲0.1096%	25.2123%	100.0560	▲0.1116%	6,300.0
5年利付国債	148	0.005%	25,000	2021/7/9	2026/6/20	71,925.0	20,356.0	100.5700	▲0.1090%	54.6867%	100.6000	▲0.1150%	4,636.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/7/8	2021/7/9	▲ 0.350	4	4		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/7/8	2021/7/9	▲ 0.350	0	0				

●2021年7月9日の予定

*5月の特定サービス産業動態統計速報	*米国5月の卸売売上高	*国庫短期証券(1007回)入札(3ヶ月、53,000億円、7/12発行)
*6月のマネーストック		*エネルギー対策借入(8,000億円、7/20借入)

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入